

Central Daily Market Report

2016年7月1日(金)

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位：億円	2016年7月1日		2016年7月4日		2016年7月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		700		2,000	
財政	▲ 1,800		▲ 34,000		5,000	
資金過不足	▲ 2,700		▲ 33,300		7,000	
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出						
全店共通	100	▲ 200	2,800	▲ 4,200	100	▲ 600
国債買現						
国庫短期証買入					20,000	
国債買入	12,700				12,500	
CP等買入				▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
ETF買入						
国債補完供給		100				
当預増減	10,000		▲ 34,800		39,000	
当座預金残高	3,042,800		3,008,000		3,047,000	
準備預金残高	2,725,600					
積み終了先	2,249,600		7月4日以降の残り所要積立額		積数 1,800	
超過準備	2,249,600		1日平均		200	
非準備預金先	317,200					
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額					2,064,300	
準備預金進捗率	実績	99.91%	日数	60.00%		

●2016年7月1日の市場動向

<インターバンク市場>

午前8時発表の準備預金残高見込みは、前日比横ばいの225兆4,000億円(当座預金残高見込みは304兆2,000億円)。朝方の無担O/N物は地銀・信託・証券より▲0.08~▲0.07%の調達希望で始まった。期明け要因から前日より上昇基調で推移し、▲0.07~▲0.06%の出会いとなった。一巡後は▲0.04~▲0.02%の出会いも見られ、調達意欲は旺盛であった。ターム物も期が明けたことで幅広い期間で出会いが散見された。本日の共通担保資金供給オペは、3M物が1兆5,000億円でオファーされ、応札額60億円(期落ち分560億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(7/4-7/5)は、▲0.09~▲0.085%程度の出会い。S/N(7/5-7/6)は、▲0.095~▲0.09%程度の出会い。S/N(7/5-6)は、国債・短国の買入オペが通知された影響でレートは低下した。SCは、新規・ロールオーバーともに幅広い銘柄で取引が見られた。個別銘柄では、5y128、10y338~10y343、20y155~156、30y48~51、40y9などにビッドの出入りが多く見られた。

<短国市場>

現先レートS/Nは低水準で推移した。アウトライト市場は短国買入オペが前回比5,000億円増額の20,000億円でオファーされた。事前予想通りの増額オファーとなったものの、流動性の無いマーケットを反映し、平均利回較差+0.018%、按分利回較差+0.012%と小甘い結果となった。オペ後は6M物で▲0.30%の出会いが見られた。

<CP市場>

CP市場は、鉄鋼、石油等の業態でまとまった額の調達が行われ、発行総額は1,600億円程と、償還総額700億円程を上回った。期間の短い物、残高が積みあがっている物のレートが多少上昇する傾向にあるものの、全体としては0%近辺で決着した。

●短期金融市場関連指標

2016/7/1	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	単位：%	最低	最高	平均	最低	最高			平均	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.075	0.050	▲ 0.058				-	▲ 0.080	▲ 0.259	▲ 0.025	15,682.48	106.56	103.08-10	102.54-56
T/N			▲ 0.030				-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.001	▲ 0.035				-	▲ 0.098						
2W	▲ 0.050	0.000	▲ 0.036				-	▲ 0.100						
3W							-	▲ 0.106						
1M	▲ 0.040	0.003	▲ 0.011				-	▲ 0.113						
3M							▲ 0.328	▲ 0.204						
6M							▲ 0.283	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.311	▲ 0.230						
									日付	6/24	6/27	6/28	6/29	6/30
									日銀当預残	3,028,000	3,010,700	3,032,300	3,036,300	3,032,800
									準備預金残	2,733,900	2,721,600	2,739,000	2,740,300	2,725,900
									マネタリーベース	4,031,600	4,014,700	4,037,200	4,042,400	4,039,400
									無担O/N加重平均	▲0.062%	▲0.061%	▲0.062%	▲0.061%	▲0.064%
									コール市場残高	67,790	68,461	66,789	68,734	58,667
									うち無担	47,532	47,549	45,835	48,776	43,033
									うち有担	20,258	20,912	20,954	19,958	15,634

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額(億円)	応募額(億円)	募入最低額	募入最高利回	棄分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●オペ結果

種類	オファー額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率	応札総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	按分レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均落札レート・利回較差・価格較差	按分比率
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	15,000	2016/7/5	2016/10/14		60	60				
国庫短期証券買入	20,000	2016/7/5			41,482	20,001	0.012		0.018	75.0
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,750	2016/7/5			9,245	3,750	▲0.014		▲0.010	90.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,400	2016/7/5			9,991	4,402	▲0.022		▲0.019	69.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,300	2016/7/5			12,536	4,304	▲0.016		▲0.014	7.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	12,801	2016/7/1	2016/7/4		47	47		▲0.600	▲0.600	

●2016年7月4日の予定

*6月のマネタリーベース	*米国祝日(Independence Day)
*6月実績/7月見込み財政資金対民間収支	

◆本資料は信頼できると思われる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

◆本資料は何かの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。

◆金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目録見書をよくお読みください。

セントラル短資株式会社 登録金融機関関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入